

南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金 2015|第二季度报告

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2015年7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年04月01日起至2015年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方中债中期票据指数债券型发起式
交易代码	000022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月1日
报告期基金总资产	56,463.79万元
基金净值	1.00元
基金份额净值	1.00元
本报告期内基金的平均净值	1.00元
本基金主要投资于债券类金融工具，主要采取被动复制策略，以跟踪标的指数的构成比例为依据，结合对利率、信用利差、收益率曲线等的分析，通过久期调整、期限结构配置、券种选择、杠杆操作等方法，在严格控制风险的前提下，力争获得与标的指数相似的收益。	本基金主要投资于债券类金融工具，主要采取被动复制策略，以跟踪标的指数的构成比例为依据，结合对利率、信用利差、收益率曲线等的分析，通过久期调整、期限结构配置、券种选择、杠杆操作等方法，在严格控制风险的前提下，力争获得与标的指数相似的收益。
基金经理	孟飞
基金类型	债券型
基金规模	南方中债中期票据指数债券型发起式
下级基金的基金简称	A
下级基金的交易代码	000022
报告期末基金的份额总额	47,817,720.79份
报告期末基金的份额总额	4,090,743,00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

注：本基金本报告期尚未持有股票

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期尚未持有股票

5.3 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期尚未持有股票

5.4 报告期按债券品种分类的债券投资组合

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2. 所述基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中债中期票据指数债券型发起式A

注：南方中债中期票据指数债券型发起式C

注：南方中债中期票据指数债券型发起式C

注：南方中债中期票据指数债券型发起式A

<p